

NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 12 MARZO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	280615	mxAAA	2,500,000	249,835,895.00	10.11
LF	BONDES F	271202	mxAAA	2,000,000	200,113,936.00	8.10
LF	BONDES F	270923	mxAAA	2,000,000	199,658,522.00	8.08
LF	BONDES F	280127	mxAAA	1,000,000	100,017,790.00	4.05
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FHIPOCB	21-3	HR AAA	5,833,000	327,255,215.30	13.25
95	FOVISC B	18U	AAA.mx	523,979	147,481,087.97	5.97
95	FHIPOCB	17U	AAA(mex)	568,034	138,648,163.09	5.61
95	FOVISC B	19-2U	AAA.mx	261,572	124,421,835.79	5.04
95	FHIPOCB	20	mxAAA	2,058,860	71,870,546.94	2.91
95				434,258	137,548,863.77	5.57
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	270902	mxAAA	20,000,000	178,935,100.00	7.24
BI	CETES	270513	mxAAA	17,500,000	160,615,210.00	6.50
BI	CETES	271028	mxAAA	11,500,000	101,636,563.00	4.11
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,138,038,728.86	86.54
REPORTO						
LF	BONDES F	290111	mxAAA	3,338,134	331,378,138.90	13.41
TOTAL REPORTO					331,378,138.90	13.41
OTROS VALORES				10,980	1,095,311.05	0.04
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,470,512,178.81	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
 AA Af/S3

VaR Promedio
 0.104%

Límite de VaR
 2.690%

ACTIVOS NETOS
 2,468,592,548.82

Para el cálculo del VaR se utiliza el método histórico con un nivel de confianza del 95% a dos colas, una muestra de 500 observaciones y un horizonte de tiempo a 1 día.

La inversión en instrumentos respaldados por activos conlleva riesgos asociados a la volatilidad de los factores que influyen en el activo subyacente. Fluctuaciones en tasas de interés, inflación, riesgo de impago, entre otros, pueden afectar adversamente el valor del instrumento, incrementando su volatilidad y por consiguiente el riesgo.